

Einladung zum Mathematischen Kolloquium

Julius-Maximilians-Universität Würzburg • Fakultät für Mathematik und Informatik

Prof. Dr. Rüdiger Seydel

Universität zu Köln

Computational Finance

Donnerstag, den 8.. Nov. 2012 • 16:15 Uhr

Mathematik Ost (Emil-Fischer-Straße 40), Seminarraum SE40 (Raum 00.001)

Inhaltsangabe

The talk is divided into three parts. In the first part the focus is on options as a prime instrument on financial markets. Terminology and basic mathematical aspects are introduced. Then, in the second part, we outline several classes of computational approaches devoted to the valuation of options. This includes tree methods, Monte Carlo and PDE methods. In the third part of the talk we sketch a few recent research issues of numerical methods.



www.mathematik.uni-wuerzburg.de/kolloquium.html

Zu diesem Vortrag laden wir Sie herzlich ein.
Im Anschluss an die Vorträge Kaffee und Tee im Foyer vor dem SE40.

Die Dozentinnen und Dozenten der Mathematik

